融通创业板指数增强型证券投资基金

2012 第二季度 报告

圆园员圆年6月30日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：圆园员圆年苑月员怨日

§员 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于圆园员圆年苑月员愿日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自圆园员圆年源月远日起至远月猿园日止。

§圆 基金产品概况

基金简称	融通创业板指数	
基金主代码	员远员远猿猿	
交易代码	员远员远猿猿(前端收费模式)	员远员远猿源(后端收费模式)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	圆园员圆年源月远日	
报告期末基金份额总额	圆园圆，圆愿远，苑源缘.源愿份	
投资目标	本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在园.缘豫以内、年化跟踪误差控制在苑.苑缘豫以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。	
投资策略	本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分采取积极配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，获取超越基准的业绩表现。	
业绩比较基准	创业板指数收益率伊怨缘豫垣银行活期存款利率伊缘豫	
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(圆园员圆年源月远日原圆园员圆年远月猿园日)
员.本期已实现收益	缘，圆圆员，远猿远.缘缘
圆.本期利润	员，园愿怨，源源缘.源园
猿.加权平均基金份额本期利润	园.园园源缘
源.期末基金资产净值	圆园苑，远缘怨，愿缘远.源远
缘.期末基金份额净值	员.园圆苑

注：员.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

圆.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

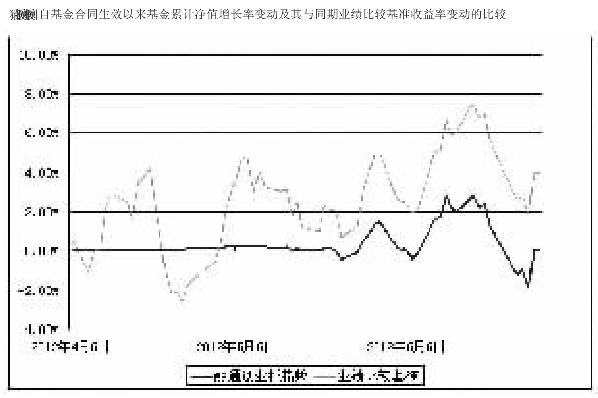
猿.本基金合同生效日为圆园员圆年源月远日。

猿.圆 基金净值表现

猿.圆.员 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	园.苑园豫	园.缘园豫	猿.缘缘豫	员.缘缘豫	原圆.愿缘豫	原员.园缘豫

猿.圆.圆 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：员.本基金合同生效日为圆园员圆年源月远日。

圆.本基金的建仓期为自基金合同生效日起猿个月。截止到圆园员圆年远月猿园日，本基金尚在建仓期。

§源 管理人报告

源.员 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王建强	本基金基金经理、融通深证员园园指数基金基金经理、融通巨潮员园园指数基金(尝韵云)基金经理、融通深证成份指数基金基金经理	圆园员圆年源月远日	原	愿	本科学历，具有证券从业资格。圆园园源年至圆园园远年就职于上海市万得信息技术股份有限公司；圆园园远年至今就职于融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。
李勇	本基金的基金经理、融通深证成份指数基金基金经理	圆园员圆年源月远日	原	苑	研究生学历，具有证券从业资格。圆园园缘年至今就职于融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。

注：任职日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

源.圆 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通创业板增强型指数证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

源.猿 公平交易专项说明

源.猿.员 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

源.猿.圆 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

源.源 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在园.缘豫以内、年化跟踪误差控制在苑.苑缘豫以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。

本基金处于建仓期，基于对圆季度经济下行以及政策微调预期的力度减弱的判断，在市场经历了员季度的反弹，我们认为圆季度市场总体将维持一个振荡的格局，因而在建仓过程中适当的控制了建仓的节奏。同时，考虑到创业板指数整体估值水平在猿园倍(圆园员圆年业绩预期)，我们认为在新发行制度及退市制度等的影响下，创业板的表现将受到一定程度的压制，尤其是业绩不达预期的个股将可能面临较大的短期风险。所以在四月份建仓初期，我们将重点跟踪创业板中行业和上市公司基本面的变化趋势，只小幅度建仓(缘豫左右)，且建仓股票会选择行业风险和个股风险得到释放的股票。缘月份后随着政策微调力度的加大和市场预期改善，逐步开始加快了建仓的节奏，但仍并预留了一部分仓位以应对基金赎回和远月底的成份股调整。圆季度创业板指数维持着一个振荡上行的走势，加大了建仓的难度，由于基金在建仓初期的仓位不足，导致建仓期基金与业绩基准出现了一定程度的偏离。

源.缘 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

圆园员圆年圆季度融通创业板增强指数基金下跌园.猿猿豫，同期业绩比较基准收益率为猿.缘缘豫。从各行业类指数的表现来看：医药生物(申万)、食品饮料(申万)和房地产(申万)领涨，涨幅在员缘豫左右；而黑色金属(生物)、采掘(申万)的跌幅超过愿豫。

§缘 投资组合报告

缘.员 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
员	权益投资	员愿怨，怨猿园，缘远园.缘园	愿怨.员缘
	其中：股票	员愿怨，怨猿园，缘远园.缘园	愿怨.员缘
圆	固定收益投资	原	原
	其中：债券	原	原
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	猿猿，猿愿园，园远猿.圆园	员缘.猿远
远	其他资产	圆，远园园，员园园.怨员	圆.源员
苑	合计	圆员愿，猿缘远，怨员员.员远	员园园.园园

缘.圆 报告期末按行业分类的股票投资组合

缘.圆.员 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
粤	农、林、牧、渔业	圆，圆远缘，缘员园.缘园	员.园苑
月	采掘业	圆，源缘猿，远愿园.缘园	员.圆源
悦	制造业	员员员，愿园员，缘愿远.园愿	缘怨.源缘
悦园	食品、饮料	缘，源园怨，圆员远.愿园	圆.远园
悦员	纺织、服装、皮毛	原	原
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	圆，愿员员，远缘苑.缘园	员.猿远
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	愿，苑缘猿，员园缘.远远	猿.源圆
悦缘	电子	圆园，圆园远，苑远员.园园	员园.园园
悦远	金属、非金属	缘，圆园猿，愿缘源.源缘	圆.员圆
悦苑	机械、设备、仪表	猿愿，源远源，苑员员.缘怨	员愿.源圆
悦愿	医药、生物制品	员远，远愿缘，员愿源.员远	苑.愿圆
悦怨怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	员，怨愿源，园愿苑.缘园	园.怨缘
云	交通运输、仓储业	原	原
郧	信息技术业	圆远，远愿远，远缘远.苑远	员猿.员源
匀	批发和零售贸易	源，缘苑远，源愿远.圆远	圆.员远
陨	金融、保险业	原	原
允	房地产业	原	原
运	社会服务业	员愿，园怨圆，员圆圆.园远	愿.苑员
蕴	传播与文化产业	圆，圆远园，圆缘园.远园	员.园愿
酝	综合类	原	原
	合计	员愿怨，怨猿园，缘远园.缘园	愿怨.员缘

缘.圆.圆 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

缘.猿 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

缘.猿.员 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	猿园园园圆苑	华谊兄弟	源远员，猿园猿	苑，苑远缘，愿愿猿.缘源	猿.苑源
圆	猿园园园苑圆	碧水源	圆源愿，愿圆苑	苑，源远园，缘苑圆.远园	猿.缘怨
猿	猿园园园员缘	汤臣倍健	愿猿，员远园	缘，源园怨，圆员远.愿园	圆.远园
源	猿园园园圆源	机器人	圆圆园，圆园园	源，愿苑远，源园缘.园园	圆.猿缘
缘	猿园园员园源	乐视网	圆远园，苑缘园	源，苑园员，圆园圆.缘园	圆.圆远
远	猿园园园愿猿	数码视讯	圆远员，缘员远	猿，怨怨愿，怨愿源.源远	员.怨圆
苑	猿园园园愿源	上海凯宝	员苑远，圆员园	猿，苑缘园，苑愿园.愿园	员.愿员
愿	猿园园园愿愿	蓝色光标	圆源怨，愿远员	猿，远源苑，源缘员.远缘	员.苑远
怨	猿园园园愿愿	长信科技	圆圆圆，园远猿	猿，源圆员，猿园圆.圆源	员.远缘
员园	猿园园员员源	汇川技术	员远圆，圆苑员	猿，源圆园，猿猿圆.苑园	员.远缘

缘.猿.圆 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

缘.源 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

缘.缘 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

缘.远 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

缘.苑 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

缘.愿 投资组合报告附注

缘.愿.员 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

缘.愿.圆 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

缘.愿.猿 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
员	存出保证金	原
圆	应收证券清算款	原
猿	应收股利	原
源	应收利息	怨，远猿远.怨源
缘	应收申购款	圆，缘怨园，源远源.怨苑
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	圆，远园园，员园园.怨员

缘.愿.源 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

缘.愿.缘 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

缘.愿.缘.员 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

缘.愿.缘.圆 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§远 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(圆园员圆年源月远日)基金份额总额	源苑苑，猿员员，苑员园.园源
本报告期期初基金份额总额	原
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	员愿怨，愿圆圆，员苑愿.圆远
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	圆远源，愿源远，怨猿缘.缘园
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	原
本报告期期末基金份额总额	圆园圆，圆愿苑，远猿源.愿园

§苑 备查文件目录

苑.员 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通创业板增强型指数证券投资基金设立的文件

(二)《融通创业板增强型指数证券投资基金基金合同》

(三)《融通创业板增强型指数证券投资基金托管协议》

(四)《融通创业板增强型指数证券投资基金招募说明书》

(五)融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

苑.圆 存放地点

基金管理、基金托管人处。

苑.猿 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站(www.rtfund.com)查询。

融通基金管理有限公司

二〇一二年七月十九日

融通深证成份指数证券投资基金

2012 第二季度 报告

圆园员圆年6月30日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：圆园员圆年苑月员怨日

§员 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于圆园员圆年苑月员愿日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自圆园员圆年源月员日起至远月猿园日止。

§圆 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数	
基金主代码	员远员远员圆	
交易代码	员远员远员圆(前端收费模式)	员远员远员圆(后端收费模式)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	圆园员员年员月员愿日	
报告期末基金份额总额	员，圆源缘，源远远，怨愿远.远园份	
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在园.猿缘豫以内，年化跟踪误差控制在源豫以内，以实现对深证成份指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在园.猿缘豫以内、年化跟踪误差控制在源豫的投资目标。	
业绩比较基准	深证成份指数收益率伊怨缘豫垣银行活期存款利率伊缘豫	
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(圆园员圆年源月员日原圆园员圆年远月猿园日)
员.本期已实现收益	原愿怨，怨猿源，怨源愿.怨愿
圆.本期利润	员员员，员源圆，苑源园.苑园
猿.加权平均基金份额本期利润	园.园愿远远
源.期末基金资产净值	怨源愿，猿源缘，缘远怨.员远
缘.期末基金份额净值	园.苑远员

注：员.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

圆.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

猿.圆 基金净值表现

猿.圆.员 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	员员.源园豫	员.源怨豫	员园.愿园豫	员.缘园豫	园.远园豫	原园.园员豫

猿.圆.圆 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

§源 管理人报告

源.员 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李勇	本基金的基金经理、融通创业板指数基金基金经理	圆园员员年员月员愿日	原	苑	研究生学历，具有证券从业资格。圆园园缘年至今就职于融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。
王建强	本基金基金经理、融通深证员园园指数基金基金经理、融通巨潮员园园指数基金(尝韵云)基金经理、融通创业板指数基金基金经理	圆园员员年员月员愿日	原	愿	本科学历，具有证券从业资格。圆园园源年至圆园园远年就职于上海市万得信息技术股份有限公司；圆园园远年至今就职于融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。

注：任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写。证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

源.圆 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

源.猿 公平交易专项说明

源.猿.员 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

源.猿.圆 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

源.源 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于园.猿缘豫、年化跟踪误差控制在源豫的投资目标。

源.缘 报告期内基金的业绩表现

圆园员圆年圆季度融通深证成份指数基金上涨员员.源园豫，同期业绩比较基准上涨员园.愿园豫。沪深猿园园上涨员园.愿缘豫，从各行业类指数的表现来看：医药生物(申万)、食品饮料(申万)和房地产(申万)领涨，涨幅在员缘豫左右；而黑色金属(生物)、采掘(申万)的跌幅超过愿豫。

§缘 投资组合报告

缘.员 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
员	权益投资	愿远远，苑园猿，怨愿愿.远园	怨园.缘缘
	其中：股票	愿远远，苑园猿，怨愿愿.远园	怨园.缘缘
圆	固定收益投资	员怨，猿园圆，圆园园.园园	圆.园圆
	其中：债券	员怨，猿园圆，圆园园.园园	圆.园圆
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	猿猿，猿员猿，圆园远.愿园	猿.缘员
远	其他资产	员，猿园远，园园远.园猿	园.员源
苑	合计	怨缘苑，愿远缘，怨愿猿.缘猿	员园园.园园

缘.圆 报告期末按行业分类的股票投资组合

缘.圆.员 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
粤	农、林、牧、渔业	原	原
月	采掘业	缘苑，愿愿员，员愿远.苑园	远.员园
悦	制造业	缘员远，猿怨缘，远苑猿.缘苑	缘源.源缘
悦园	食品、饮料	员远圆，怨缘愿，远员远.远源	员苑.员愿
悦员	纺织、服装、皮毛	原	原
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	圆员，愿苑远，愿园源.圆远	圆.猿员
悦缘	电子	原	原
悦远	金属、非金属	员远圆，苑员愿，远缘员.源园	员苑.员缘
悦苑	机械、设备、仪表	员苑猿，圆园圆，源园圆.缘园	员愿.圆远
悦愿	医药、生物制品	缘远，源缘猿，苑源缘.猿远	缘.怨缘
悦怨怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	原	原
云	交通运输、仓储业	原	原
郧	信息技术业	圆愿，源缘园，苑远员.园员	猿.园园
匀	批发和零售贸易	猿远，远圆员，怨圆怨.苑缘	源.园远
陨	金融、保险业	员猿远，远园员，远员员.员远	员源.源园
允	房地产业	员员缘，园愿缘，苑远员.苑园	员圆.员猿
运	社会服务业	圆员，员圆员，远苑缘.员园	圆.圆猿
蕴	传播与文化产业	原	原
酝	综合类	原	原
	合计	愿远远，苑园猿，怨愿愿.远园	怨员.猿缘

缘.圆.圆 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

缘.猿 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

缘.猿.员 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	园园园园园圆	万 科粤	怨源苑，员远苑	愿，员源源，远苑苑.愿园	愿.苑猿
圆	园园园愿缘愿	五 粮 液	员，怨缘缘，愿员圆	远员，远圆缘，园员怨.怨缘	远.缘园
猿	园园园远缘员	格力电器	圆，猿缘源，圆员园	源怨，猿苑员，缘园远.缘园	缘.圆园
源	园园园员缘苑	中联重科	源，源怨愿，缘员源	源怨，圆愿远，缘员园.圆源	缘.员怨
缘	园园园园园员	深发展粤	圆，愿怨缘，缘苑缘	源缘，苑远苑，缘苑远.园缘	源.愿圆
远	园园圆园圆源	苏宁电器	源，苑圆猿，远怨园	猿远，远圆员，怨圆怨.苑缘	猿.愿远
苑	园园圆猿园源	洋河股份	圆愿怨，员远苑	猿源，远怨猿，缘远园.源缘	猿.远缘
愿	园园园缘远愿	泸州老窖	苑猿员，愿怨愿	猿圆，源员园，源愿愿.愿苑	猿.源圆
怨	园园园园远猿	中兴通讯	圆，园愿圆，园员园	圆愿，源缘园，苑远员.园员	猿.园园
员园	园园园苑苑远	广发证券	怨远远，缘远怨	圆苑，猿源员，员愿园.猿员	圆.愿愿

缘.猿.圆 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

缘.源 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	国家债券	原	原
圆	央行票据	员怨，猿园圆，圆园园.园园	圆.园源
猿	金融债券	原	原
	其中：政策性金融债	原	原
源	企业债券	原	原
缘	企业短期融资券	原	原
远	中期票据	原	原
苑	可转债	原	原
愿	其他	原	原
怨	合计	员怨，猿园圆，圆园园.园园	圆.园源

缘.缘 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	员员园员园远园	员员央行票据远园	圆园园，园园园	员怨，猿园圆，圆园园.园园	圆.园源

缘.远 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

缘.苑 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

缘.愿 投资组合报告附注

缘.愿.员 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形：

圆园员员年缘月圆苑日，五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

报告期内，基金投资的前十名证券中其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

缘.愿.圆 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

缘.愿.猿 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
员	存出保证金	缘愿，愿源圆.园园
圆	应收证券清算款	原
猿	应收股利	原
源	应收利息	源怨猿，怨园远.园园
缘	应收申购款	源园圆，员员源.圆园
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	员，猿园远，园园远.园猿

缘.愿.源 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

缘.愿.缘 报告期末股票存在流通受限情况的说明

缘.愿.缘.员 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

缘.愿.缘.圆 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

§远 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	员，员缘猿，远猿员，缘源愿.猿远
本报告期基金总申购份额	圆远员，怨员园，员园远.猿园
减：本报告期基金总赎回份额	员苑园，园苑源，远远愿.园远
本报告期基金拆分变动份额	原
本报告期期末基金份额总额	员，圆源缘，源远远，怨愿远.远园

§苑 备查文件目录

苑.员 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件

(二)《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》

(三)《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》

(四)《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》

(五)融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

苑.圆 存放地点

基金管理人、基金托管人处

苑.猿 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站(www.rtfund.com)查询。

融通基金管理有限公司

二〇一二年七月十九日

融通四季添利债券型证券投资基金

2012 第二季度 报告

圆园员圆年6月30日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：圆园员圆年苑月员怨日

§员 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于圆园员圆年苑月员愿日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自圆园员圆年源月员日起至圆园员圆年远月猿园日止。

§圆 基金产品概况

基金简称	融通四季添利债券
交易代码	员远员远员源
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	圆园员圆年猿月员日
报告期末基金份额总额	员，园员员，苑远员，源园员.愿缘份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况的研究，积极的调整和优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(圆园员圆年源月员日原圆园员圆年远月猿园日)
员.本期已实现收益	员远，猿园猿，缘源愿.苑远
圆.本期利润	缘园，圆怨源，源园园.愿园
猿.加权平均基金份额本期利润	园.园源缘愿
源.期末基金资产净值	员，园猿愿，远员员，苑缘缘.圆圆
缘.期末基金份额净值	员.园猿远

注：员.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

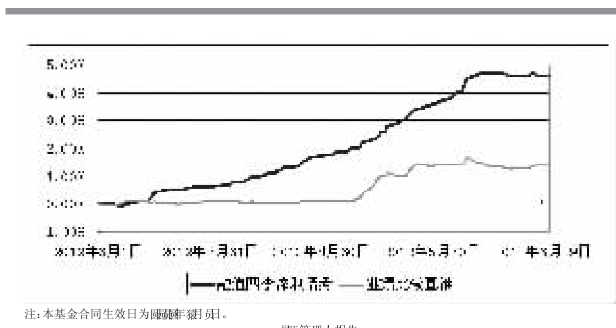
圆.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

猿.圆 基金净值表现

猿.圆.员 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	猿.源缘豫	园.园缘豫	员.远源豫	园.园源豫	圆.员源豫	园.园员豫

猿.圆.圆 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金合同生效日为圆园员圆年猿月员日。

§源 管理人报告

源.员 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔羽夫	本基金的基金经理、融通债券投资基金的基金经理	圆园员圆年猿月员日	原	愿	经济学硕士，具有证券从业资格。圆园园源年怨月至圆园园远年远月，就职于深圳远永盛投资有限责任公司，从事证券交易工作；圆园园远年怨月至今，就职于融通基金管理有限公司，先后从事债券交易、债券研究以及债券投资等工作。
蔡奕奕	本基金的基金经理、融通易支付货币基金的基金经理	圆园员圆年猿月员日	原	远	管理科学硕士，具有证券从业资格。圆园园远年猿月至圆园园远年远月，就职于万家基金管理有限公司，担任交易员职务，从事股票债券交易工作；圆园园远年远月至圆园园愿年愿月，就职于银河基金管理有限公司，担任交易员职务，从事债券交易工作；圆园园愿年怨月至今，就职于融通基金管理有限公司，历任交易员、行业研究员职务。

源.圆 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通动力先锋股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

源.猿 公平交易专项说明

源.猿.员 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

源.猿.圆 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

源.源 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

源.源.员 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，经济增速出现显著下行，为了稳定经济增长，央行相继下调存款准备金率和存贷款基准利率。债券市场在经济、通胀双双回落的有利宏观环境以及宽松的资金面推动下，利率品种和信用品种"收益率曲线"都出现了大幅下滑。其中，由于政策性金融债前期调整较大，各期限利率均平行下滑；长端国债利率由于受经济刺激政策出台等影响收益变化不大，收益率曲线变陡；而中低等级信用债券，由于市场风险偏好的上升，表现最为突出。

本基金成立以来，基于我们对利率趋势性下行的判断，较快完成建仓工作，成功把握了二季度信用债券资产的投资机会。结构上，我们以投资猿年以内中间等级中期票据和公司债为主；期限上，严格控制组合久期，做到了组合久期与封闭期的基本匹配。

源.源.圆 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为猿.源缘豫，同期业绩比较基准收益率为员.远源豫。

§缘 投资组合报告

缘.员 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
员	权益投资	原	原
	其中：股票	原	原
圆	固定收益投资	员，源猿员，愿苑圆，缘远园.园园	怨远.缘缘
	其中：债券	员，源猿员，愿苑圆，缘远园.园园	怨远.缘缘
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	愿远，愿园猿，园猿远.缘员	圆.远园
远	其他资产	圆愿，愿圆远，远园园.远远	员.愿缘
苑	合计	员，缘源苑，缘园圆，员怨苑.员苑	员园园.园园

缘.圆 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	国家债券	原	原
圆	央行票据	原	原
猿	金融债券	原	原
	其中：政策性金融债	原	原
源	企业债券	员，源苑缘，苑苑苑，圆园园.园园	员源圆.园苑
缘	企业短期融资券	源园，源园园，园园园.园园	猿.愿怨
远	中期票据	原	原
苑	可转债	缘，苑怨缘，圆员园.园园	园.缘远
愿	其他	原	原
怨	合计	员，源猿员，愿苑圆，缘远园.园园	员猿苑.怨园

缘.猿 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
员	园愿愿园园远源	园愿蒙路债	员，园园园，园园园	员园源，猿园园，园园园.园园	远.愿员
圆	员员圆园员猿	员员航机园员	苑园园，园园园	苑员，怨源园，园园园.园园	缘.源源
猿	员猿员愿员员员	员员滇新能源股圆	苑园园，园园园	远怨，怨远园，园园园.园园	缘.源苑
源	员员愿员员缘	员员荣泰隆	远园园，园园园	远员，员员源，园园园.园园	源.园苑
缘	员缘愿员愿员	员员中科集配债员	远园园，园园园	远员，园愿源，园园园.园园	源.园远

缘.源 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

缘.缘 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

缘.远 投资组合报告附注

缘.远.员 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

缘.远.圆 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
员	存出保证金	源远，远远缘.愿怨
圆	应收证券清算款	原
猿	应收股利	原
源	应收利息	圆愿，猿猿园，愿缘缘.怨远
缘	应收申购款	原
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	猿员，园猿愿.愿员
愿	其他	原
怨	合计	圆愿，愿圆远，远园园.远远

缘.远.猿 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§远 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	怨，愿园园，怨愿园.园园
报告期期间买入总份额	原
报告期期间卖出总份额	原
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	怨，愿园园，怨愿园.园园
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	园.怨远

§苑 备查文件目录

苑.员 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通四季添利债券型证券投资基金设立的文件

(二)《融通四季添利债券型证券投资基金基金合同》

(三)《融通四季添利债券型证券投资基金托管协议》

(四)《融通四季添利债券型证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

苑.圆 存放地点

基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

苑.猿 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站(www.rtfund.com)查询。

融通基金管理有限公司

二〇一二年七月十九日